

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2019 roku**

UFK Portfel Zrównoważony typu E pro
PKO Życie Towarzystwo Ubezpieczeń SA

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	281 322,62	410 953,33
1.	lokaty	281 322,62	410 953,33
2.	środki pieniężne	0,00	0,00
3.	należności	0,00	0,00
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	0,00	0,00
II.	Zobowiązania	0,00	575,36
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	0,00	575,36
III.	Aktywa netto (I-II)	281 322,62	410 377,97

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	212 784,19	281 322,62
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	88 959,89	127 410,29
I.	Zwiększenia funduszu	162 587,78	186 379,51
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	159 899,46	183 002,74
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	2 688,32	3 376,77
II.	Zmniejszenia funduszu	73 627,89	58 969,22
1.	tytułem wykupu	0,00	0,00
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	59 206,56	2 542,25
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	0,00	0,00
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	5 056,02	44 654,05
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	-77,03
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	9 365,31	11 849,95
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-20 421,46	1 645,06
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	281 322,62	410 377,97

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK uczestnictwa funduszu

Pozycja		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
I.	Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	17 050,0152	24 742,5347
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	24 742,5347	35 685,0409
II.	Wartość jednostki jednostki uczestnictwa:		
1.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na początek okresu sprawozdawczego	12,48	11,37
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	11,10	10,87
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	12,91	11,75
4.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	11,37	11,50

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	410 953,33	100,14%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
2.	obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00%
3.	inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	403 252,95	98,26%
7.	instrumenty pochodne	0,00	0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty bankowe	7 700,38	1,88%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
III.	Należności	0,00	0,00%
VI.	Zobowiązania	575,36	0,14%
V.	Aktywa netto (w tym)	410 377,97	100,00%
1	krajowe	410 377,97	100,00%
2	zagraniczne - państwa UE	0,00	0,00%
3	zagraniczne - państwa poza UE	0,00	0,00%

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

		Wartość bilansowa zł) (w	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	410 953,33	100,14%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
1.1	obligacje	0,00	0,00%
1.2	bony skarbowe	0,00	0,00%
1.3	inne	0,00	0,00%
2.	obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00%
3.	inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00%
3.1	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
3.2	pozostałe	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
4.1	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
4.2	pozostałe	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	403 252,95	98,26%
6.1	jednostki uczestnictwa	403 252,95	98,26%
6.2	certyfikaty inwestycyjne	0,00	0,00%
6.2.1	funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0,00	0,00%
6.2.2	innych funduszy inwestycyjnych	0,00	0,00%
7.	instrumenty pochodne	0,00	0,00%
7.1	opcje	0,00	0,00%
7.2	kontrakty terminowe	0,00	0,00%
7.3	swapy walutowe	0,00	0,00%
7.4	swapy procentowe	0,00	0,00%
7.5	inne instrumenty pochodne	0,00	0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
9.1	zabezpieczone hipotecznie	0,00	0,00%
9.2	zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej	0,00	0,00%
9.3	pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie	0,00	0,00%
9.4	inne pożyczki	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty bankowe	7 700,38	1,88%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
III.	Należności	0,00	0,00%
VI.	Zobowiązania	575,36	0,14%
V.	Aktywa netto (w tym)	410 377,97	100,00%
1	krajowe	410 377,97	100,00%
2	zagraniczne - państwa UE	0,00	0,00%
3	zagraniczne - państwa poza UE	0,00	0,00%